

长盛盛杰混合型证券投资基金  
(原长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金)  
2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 10 月 28 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 10 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

根据《长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金基金合同》、基金份额持有人大会于 2020 年 7 月 23 日表决通过的《关于长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金转型有关事项的议案》以及基金管理人长盛基金管理有限公司于 2020 年 7 月 24 日发布的《长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，自 2020 年 7 月 24 日起长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金转型为长盛盛杰混合型证券投资基金。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 7 月 24 日（基金合同生效日）起至 9 月 30 日止（注：长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金报告期自 2020 年 7 月 1 日起至 2020 年 7 月 23 日止）。

## § 2 基金产品概况

转型后：

基金简称	长盛盛杰混合
基金主代码	004466
交易代码	004466
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 7 月 24 日
报告期末（2020 年 9 月 30 日）基金份额总额	50,949,766.29 份
投资目标	通过优化的资产配置，前瞻性把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会，在严格控制风险的前提下满足投资者实现资本增值的投资需求。
投资策略	（一）大类资产配置 本基金将通过深入分析宏观经济指标、微观经济指标、市场指标、政策因素，动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。

	<p>(二) 股票投资策略</p> <p>在股票投资方面, 本基金管理人将全面深入地把握上市公司基本面, 运用基金管理人的研究平台和股票估值体系, 深入发掘股票内在价值, 结合市场估值水平和股市投资环境, 充分考虑行业景气程度、企业竞争优势等因素, 有效识别并防范风险, 以获取较好收益。</p> <p>(三) 债券投资策略</p> <p>本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式, 获得与风险相匹配的投资收益, 以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。</p> <p>本基金通过分析未来市场利率趋势及市场信用环境变化方向, 综合考虑不同券种收益率水平、信用风险、流动性等因素, 构造债券投资组合。在实际的投资运作中, 本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略等多种策略, 获取债券市场的长期稳定收益。</p>	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*15%+中证综合债指数收益率*85%	
风险收益特征	本基金为混合型基金, 其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金, 高于债券型基金、货币市场基金。	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长盛盛杰混合 A	长盛盛杰混合 C
下属分级基金的交易代码	009850	004466
报告期末下属分级基金的份额总额	8, 853, 666. 44 份	42, 096, 099. 85 份

转型前:

基金简称	长盛盛杰一年期
基金主代码	004466
交易代码	004466
基金运作方式	本基金为契约型开放式基金, 以定期开放方式运作
基金合同生效日	2017 年 5 月 2 日
报告期末 (2020 年 7 月 23 日) 基金份额总额	35, 022, 535. 76 份
投资目标	通过优化的资产配置, 前瞻性把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会, 在严格控制风险的前提下满足投资者实现资本增值的投资需求。
投资策略	(一) 大类资产配置: 本基金将通过深入分析宏观经济指标、微观经济指标、市场指标、政策因素, 动态调整基金资产在股票、债券、货币市场

	<p>工具等类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。</p> <p>（二）股票投资策略：在股票投资方面，本基金管理人将全面深入地把握上市公司基本面，运用基金管理人的研究平台和股票估值体系，深入发掘股票内在价值，结合市场估值水平和股市投资环境，充分考虑行业景气程度、企业竞争优势等因素，有效识别并防范风险，以获取较好收益。</p> <p>（三）债券投资策略：本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。</p> <p>（四）开放期投资策略：本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*15%+中证综合债指数收益率*85%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020年7月24日—2020年9月30日）	
	长盛盛杰混合 A	长盛盛杰混合 C
1. 本期已实现收益	217,084.77	2,213,941.25
2. 本期利润	98,464.54	-662,363.27
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0371	-0.0177
4. 期末基金资产净值	10,379,566.99	49,327,289.75
5. 期末基金份额净值	1.1723	1.1718

注：1、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、所列数据截止到 2020 年 9 月 30 日。

3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

4、长盛盛杰混合型证券投资基金由长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金转型而来，转型日期为 2020 年 7 月 24 日（即基金合同生效日）。

### 3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020 年 7 月 1 日 — 2020 年 7 月 23 日）
1. 本期已实现收益	936,442.51
2. 本期利润	1,729,692.38
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0465
4. 期末基金资产净值	41,571,342.64
5. 期末基金份额净值	1.1870

注：1、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、所列数据截止到 2020 年 7 月 23 日。

3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

### 3.2 基金净值表现（转型后）

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长盛盛杰混合 A

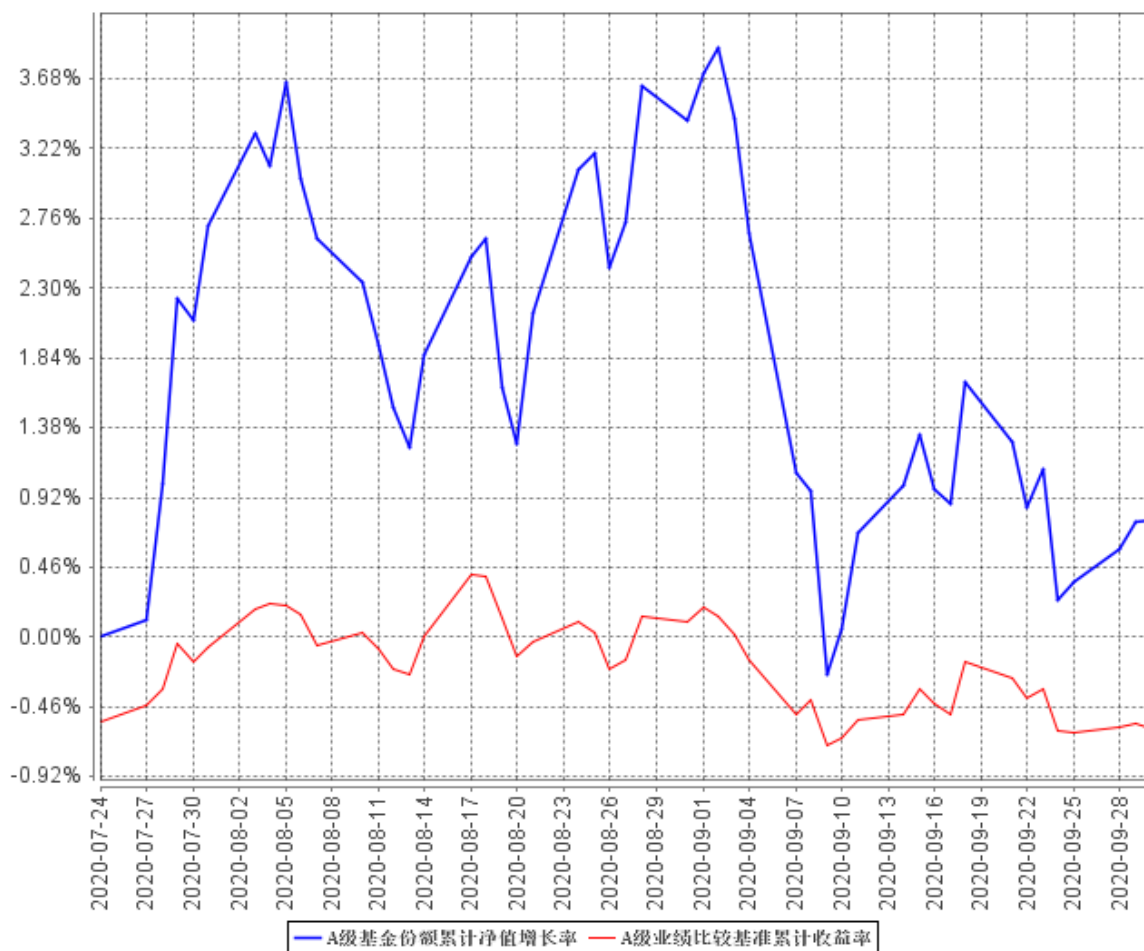
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①—③	②—④
自基金转型 起至今	0.76%	0.59%	-0.61%	0.19%	1.37%	0.40%

长盛盛杰混合 C

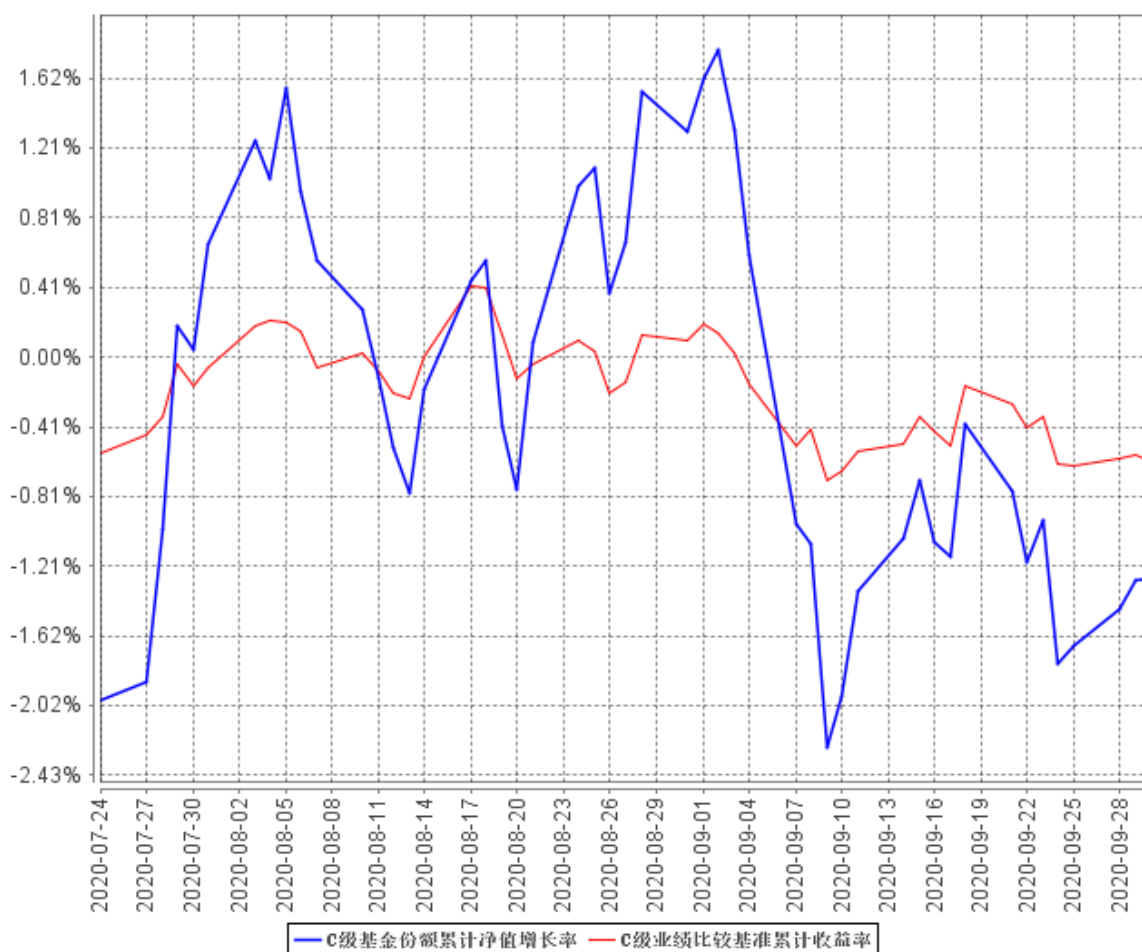
阶段	净值增长 率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①—③	②—④
自基金转型 起至今	-1.28%	0.65%	-0.61%	0.19%	-0.67%	0.46%

### 3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、长盛盛杰混合型证券投资基金由长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金转型而来，转型日期为 2020 年 7 月 24 日（即基金合同生效日）。截至本报告期末本基金自合同生效未满一年。

2、按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截止本报告期末仍处于建仓期。

3、本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 0-30%；在每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

### 3.2 基金净值表现（转型前）

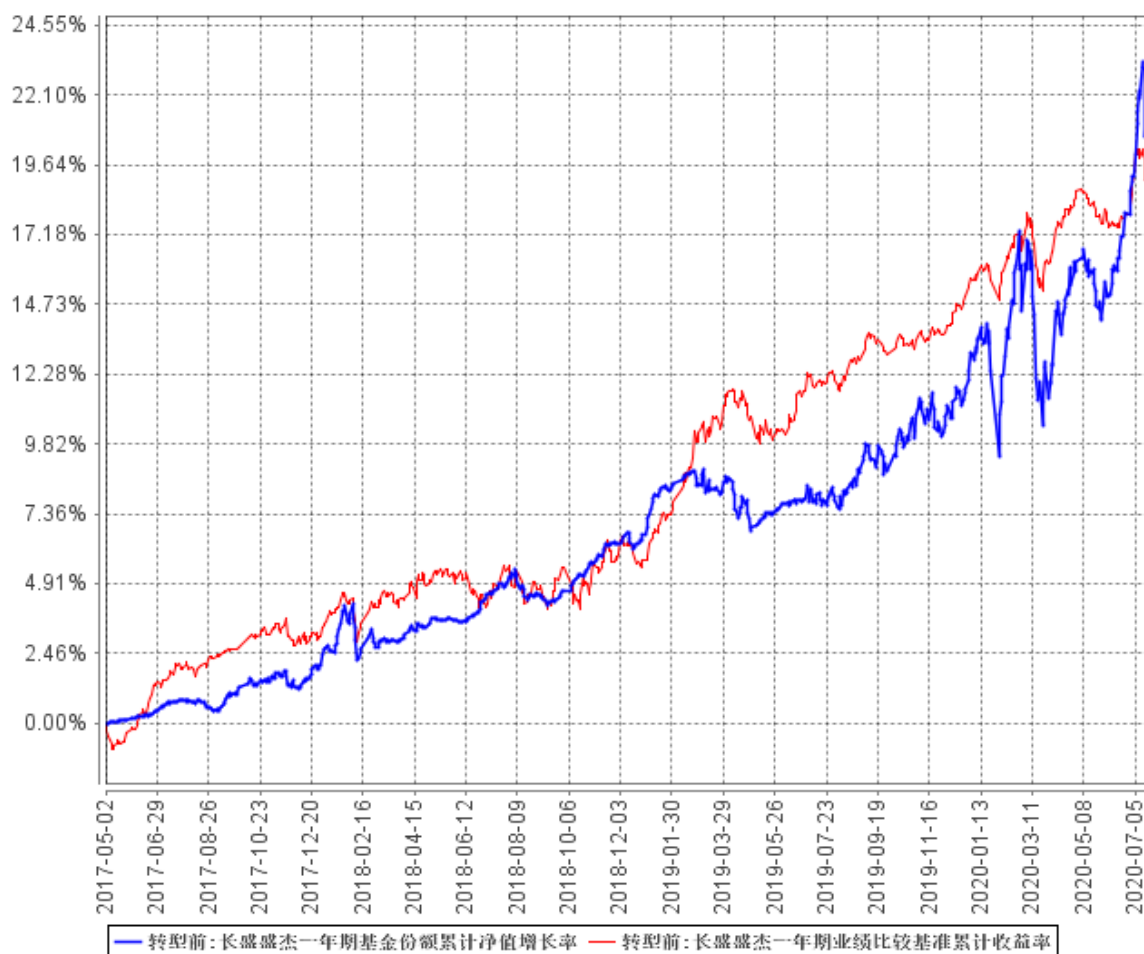
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
2020 年 7 月	4.14%	0.67%	1.70%	0.31%	2.44%	0.36%

1 日至 2020 年 7 月 23 日						
2020 年 4 月 1 日至 2020 年 7 月 23 日	10.38%	0.47%	3.38%	0.21%	7.00%	0.26%
2019 年 10 月 1 日至 2020 年 7 月 23 日	13.56%	0.53%	6.37%	0.20%	7.19%	0.33%
2017 年 10 月 1 日至 2020 年 7 月 23 日	22.14%	0.31%	17.03%	0.19%	5.11%	0.12%
自基金合同生效起至 2020 年 7 月 23 日	23.65%	0.29%	20.19%	0.18%	3.46%	0.11%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长盛盛杰一年期基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资



组合比例符合基金合同的约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨哲	本基金经理，长盛可转债债券型证券投资基金基金经理，长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理，固定收益部副总监。	2018年6月29日	2020年7月23日	10年	杨哲先生硕士。曾任大公国际资信评估有限公司公司信用分析师、信用评审委员会委员。2013年9月加入长盛基金管理有限公司，曾任信用研究员等职务。

注：1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况（转型前）

本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨哲	本基金经理，长盛可转债债券型证券投资基金基金经理，长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理，固定收益部副总监。	2020年7月24日	-	10年	杨哲先生硕士。曾任大公国际资信评估有限公司公司信用分析师、信用评审委员会委员。2013年9月加入长盛基金管理有限公司，曾任信用研究员等职务。

注：1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况（转型后）

本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、社保组合、私募资产管理计划等。具体如下：

研究支持，公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果，所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策，公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内，独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行，公司实行集中交易制度，所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定，场内交易，强制开启恒生交易系统公平交易程序；场外交易，严格遵守相关工作流程，保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估，公司风险管理部、监察稽核部，依照《公司公平交易细则》的规定，持续、动态监督公司投资管理全过程，并进行分析评估，及时向公司管理层报告发现问题，保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去 4 个季度的同向交易行为进行数量分析，计算溢价率、贡献率、占优比等指标，使用双边 90%置信水平对 1 日、3 日、5 日的交易片段进行 T 检验，未发现违反公平交易及利益输送的行为。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

##### 1、报告期内行情回顾

报告期内，经济延续修复态势，制造业投资和消费增速边际改善，出口增速也持续超出预期。货币政策维持稳健中性，更重视支持实体经济结构性货币政策，社融规模持续扩张，信贷质量有所改善。

债券市场方面，受经济边际改善、货币政策回归中性、供给增大、股市回暖等因素影响，各期限债券收益率持续上行。

股票市场呈现快速上涨后的振荡盘整走势。从行业看，申万一级行业中，仅通信、贸易、计算机指数为下跌，其余行业指数均实现上涨，其中休闲服务、军工、电气设备、汽车、食品饮料、化工等行业涨幅较大。

可转债方面，中证转债指数整体小幅上涨。7月和8月，转债跟随正股上涨后进入盘整走势；9月份，股票市场风险偏好下降，转债市场成交清淡，多数转债价格有所回落。

##### 2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内，本基金坚持稳健操作思路，实现了一定的收益。在经济延续修复、逆周期调节政策逐步加码和资金面合理充裕局面下，债券资产适度缩短久期；权益资产方面，灵活调整股票和可转债资产仓位，精选配置盈利增长确定、估值水平合理的个股和转债，减持了部分涨幅过高品种以锁定收益；同时，积极参与新股和可转债新券的发行申购，增厚组合收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 9 月 30 日，长盛盛杰混合 A 基金份额净值为 1.1723 元，本报告期（2020 年 7 月 24 日至 2020 年 9 月 30 日）基金份额净值增长率为 0.76%；截至 2020 年 9 月 30 日，长盛盛杰混合 C 基金份额净值为 1.1718 元，本报告期（2020 年 7 月 24 日至 2020 年 9 月 30 日）基金份额净值增长率为-1.28%；同期业绩比较基准收益率为-0.61%。

截至 2020 年 7 月 23 日，长盛盛杰一年期定期基金份额净值为 1.1870 元，本报告期（2020 年 7 月 1 日至 2020 年 7 月 23 日）基金份额净值增长率为 4.14%；同期业绩比较基准收益率为 1.70%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金自 2020 年 07 月 01 日至 2020 年 09 月 09 日期间出现连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

## § 5 投资组合报告

转型后:

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	17,964,770.51	28.28
	其中：股票	17,964,770.51	28.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	43,583,839.92	68.60
	其中：债券	43,583,839.92	68.60
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,316,965.20	2.07
8	其他资产	668,503.46	1.05
9	合计	63,534,079.09	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	222,000.00	0.37
B	采矿业	-	-
C	制造业	9,080,907.33	15.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	306,080.00	0.51
E	建筑业	3,377.92	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,245,750.00	2.09
J	金融业	5,620,005.26	9.41
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,283,650.00	2.15
M	科学研究和技术服务业	203,000.00	0.34
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	17,964,770.51	30.09

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	37,400	1,346,400.00	2.26
2	600519	贵州茅台	800	1,334,800.00	2.24
3	601318	中国平安	14,951	1,140,163.26	1.91
4	601336	新华保险	15,900	987,072.00	1.65
5	600309	万华化学	14,005	970,546.50	1.63
6	601128	常熟银行	120,000	937,200.00	1.57
7	002475	立讯精密	15,099	862,605.87	1.44
8	002938	鹏鼎控股	14,800	846,412.00	1.42
9	600276	恒瑞医药	8,628	774,966.96	1.30
10	601288	农业银行	240,000	760,800.00	1.27

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	8,563,138.80	14.34
2	央行票据	-	-
3	金融债券	24,511,826.00	41.05
	其中：政策性金融债	24,511,826.00	41.05
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	10,508,875.12	17.60
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	43,583,839.92	73.00

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	018006	国开 1702	117,400	11,964,234.00	20.04
2	180204	18 国开 04	100,000	10,331,000.00	17.30
3	010303	03 国债(3)	53,820	5,467,573.80	9.16
4	132007	16 凤凰 EB	26,880	2,749,824.00	4.61
5	019627	20 国债 01	23,350	2,332,665.00	3.91

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

17 中油 EB: 2019 年 8 月, 广州市生态环境局责令该单位下属广州销售分公司的金龙山加油南站限期一个月内完成地下油罐改造工作; 罚款捌万元整。本基金判断, 该事项对公司经营及信用水平影响有限, 会持续对该项事件予以关注。

除上述事项外, 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录, 无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金的前十名股票, 均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,021.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	639,660.72
5	应收申购款	300.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	23,520.76
8	其他	-
9	合计	668,503.46

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	132007	16 凤凰 EB	2,749,824.00	4.61
2	132009	17 中油 EB	1,697,436.00	2.84
3	113032	桐 20 转债	368,676.30	0.62
4	113550	常汽转债	214,101.50	0.36
5	132018	G 三峡 EB1	197,540.00	0.33
6	127006	敖东转债	160,275.00	0.27

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 转型前：

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	12,643,889.16	24.77
	其中：股票	12,643,889.16	24.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	37,186,360.70	72.85
	其中：债券	37,186,360.70	72.85
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	591,429.40	1.16
8	其他资产	624,847.84	1.22
9	合计	51,046,527.10	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	644,070.00	1.55
B	采矿业	-	-
C	制造业	8,488,872.81	20.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	328,380.00	0.79
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,062,516.54	2.56
J	金融业	837,362.81	2.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	951,517.00	2.29
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	331,170.00	0.80
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	12,643,889.16	30.41

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000858	五粮液	6,500	1,365,455.00	3.28
2	002475	立讯精密	22,799	1,308,206.62	3.15
3	000661	长春高新	2,500	1,199,750.00	2.89



4	002271	东方雨虹	14,000	784,000.00	1.89
5	002938	鹏鼎控股	14,800	715,136.00	1.72
6	000333	美的集团	10,000	701,900.00	1.69
7	002027	分众传媒	111,000	701,520.00	1.69
8	002714	牧原股份	7,000	644,070.00	1.55
9	002555	三七互娱	12,000	554,400.00	1.33
10	300059	东方财富	20,000	550,600.00	1.32

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	7,832,661.70	18.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	23,713,900.00	57.04
	其中：政策性金融债	23,713,900.00	57.04
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	5,639,799.00	13.57
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	37,186,360.70	89.45

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	018006	国开 1702	109,400	11,213,500.00	26.97
2	180204	18 国开 04	100,000	10,433,000.00	25.10
3	010303	03 国债(3)	53,820	5,495,560.20	13.22
4	132007	16 凤凰 EB	26,880	2,744,448.00	6.60
5	019627	20 国债 01	23,350	2,337,101.50	5.62

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,282.74
2	应收证券清算款	153,469.22
3	应收股利	-
4	应收利息	456,095.88
5	应收申购款	10,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	624,847.84

## 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	132007	16 凤凰 EB	2,744,448.00	6.60
2	127006	敖东转债	163,995.00	0.39

## 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	长盛盛杰混合 A	长盛盛杰混合 C
基金合同生效日（2020 年 7 月 24 日） 基金份额总额	0.00	35,022,535.76
基金合同生效日起至报告期期末基金总 申购份额	8,887,371.12	8,445,463.58
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	33,704.68	1,371,899.49
基金合同生效日起至报告期期末基金拆 分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	8,853,666.44	42,096,099.85

## § 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

报告期期初基金份额总额	44,732,602.91
报告期期间基金总申购份额	116,644.90
减：报告期期间基金总赎回份额	9,826,712.05
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列）	-
报告期期末基金份额总额	35,022,535.76

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20200701~20200909	9,272,997.03	0.00	0.00	9,272,997.03	18.20%
	2	20200701~20200909	9,272,997.03	0.00	0.00	9,272,997.03	18.20%
产品特有风险							
<p>本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，当该基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致的风险包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于 5000 万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，保护中小投资者利益。</p>							

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金基金合同》、基金份额持有人大会于 2020

年 7 月 23 日表决通过的《关于长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金转型有关事项的议案》以及基金管理人长盛基金管理有限公司于 2020 年 7 月 24 日发布的《长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，自 2020 年 7 月 24 日起长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金转型为长盛盛杰混合型证券投资基金。

## § 9 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、长盛盛杰混合型证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛盛杰混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛盛杰混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛盛杰混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 10.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

### 10.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公地址和/或基金管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-86497888。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司  
2020 年 10 月 28 日